

BBVA RMBS 23 Fondo de Titulización

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Intervalos de Fecha de Vencimiento Final / Distribution by Final Maturity Date Intervals

Activos / Assets: Préstamos hipotecarios vivienda (PHs/CTHs) / Residential mortgage loans (PTCs/MCs)

Fecha / Date: 31/07/2024

Divisa / Currency: EUR

Intervalos anuales Annual Intervals	Saldo Vivo de Principal Outstanding Principal Balance				Principal Vencido Impagado Overdue Principal				Principal Pendiente Vencimiento Outstanding Principal				Tipo Interés Interest Rate	Vida residual Residual Life
	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Media Pond. W. Average	M. Pond. Meses W. Avg. Months
2025	4	0,01	167.008,16	0,00	0	0,00	0,00	0,00	4	0,01	167.008,16	0,00	4,306%	14,843
2026	14	0,03	592.165,70	0,01	0	0,00	0,00	0,00	14	0,03	592.165,70	0,01	3,815%	25,421
2027	96	0,20	4.180.362,46	0,08	6	0,47	4.015,25	1,19	96	0,20	4.176.347,21	0,08	4,343%	37,210
2028	62	0,13	2.610.999,23	0,05	1	0,08	757,31	0,22	62	0,13	2.610.241,92	0,05	4,203%	47,707
2029	125	0,26	5.601.700,01	0,10	1	0,08	322,68	0,10	125	0,26	5.601.377,33	0,10	4,345%	60,338
2030	148	0,31	7.179.329,93	0,13	5	0,39	1.876,55	0,56	148	0,31	7.177.453,38	0,13	4,142%	71,990
2031	227	0,47	12.456.325,52	0,23	4	0,31	1.800,67	0,53	227	0,47	12.454.524,85	0,23	3,982%	83,826
2032	635	1,32	37.911.857,08	0,71	12	0,93	5.783,43	1,72	635	1,32	37.906.073,65	0,71	4,115%	96,367
2033	531	1,10	37.645.729,50	0,70	16	1,25	7.246,36	2,15	531	1,10	37.638.483,14	0,70	3,502%	108,233
2034	601	1,25	43.658.942,44	0,81	22	1,71	8.241,70	2,45	601	1,25	43.650.700,74	0,81	3,708%	119,498
2035	651	1,35	52.841.939,71	0,98	29	2,26	14.316,40	4,25	651	1,35	52.827.623,31	0,98	3,690%	132,223
2036	747	1,55	64.247.565,55	1,20	24	1,87	7.283,44	2,16	747	1,55	64.240.282,11	1,20	3,608%	143,861
2037	2.319	4,82	194.258.198,70	3,61	74	5,76	31.179,76	9,25	2.319	4,82	194.227.018,94	3,61	4,061%	156,047
2038	1.327	2,76	121.881.781,42	2,27	36	2,80	12.925,53	3,84	1.327	2,76	121.868.855,89	2,27	3,328%	168,388
2039	1.057	2,20	97.223.108,98	1,81	26	2,02	7.744,11	2,30	1.057	2,20	97.215.364,87	1,81	3,572%	179,179
2040	561	1,17	59.293.690,64	1,10	8	0,62	2.161,29	0,64	561	1,17	59.291.529,35	1,10	3,327%	191,893
2041	681	1,42	71.465.843,82	1,33	16	1,25	5.356,21	1,59	681	1,42	71.460.487,61	1,33	3,328%	204,084
2042	1.850	3,85	192.724.919,18	3,59	65	5,06	16.456,88	4,88	1.850	3,85	192.708.462,30	3,59	3,822%	215,868
2043	1.947	4,05	204.750.587,04	3,81	37	2,88	10.909,68	3,24	1.947	4,05	204.739.677,36	3,81	3,411%	228,536
2044	2.348	4,88	224.274.174,63	4,17	64	4,98	14.702,62	4,36	2.348	4,88	224.259.472,01	4,17	4,153%	239,585
2045	2.930	6,09	285.608.361,61	5,31	67	5,22	13.738,96	4,08	2.930	6,09	285.594.622,65	5,31	4,381%	252,399
2046	3.720	7,73	388.753.009,12	7,23	93	7,24	20.613,48	6,12	3.720	7,73	388.732.395,64	7,23	3,662%	263,580
2047	8.054	16,74	960.498.012,92	17,87	341	26,56	78.743,35	23,37	8.054	16,74	960.419.269,57	17,87	3,915%	275,860
2048	4.839	10,06	572.102.072,57	10,64	142	11,06	30.916,97	9,17	4.839	10,06	572.071.155,60	10,64	3,443%	287,305
2049	2.418	5,03	304.259.665,21	5,66	48	3,74	10.208,15	3,03	2.418	5,03	304.249.457,06	5,66	3,696%	298,676
2050	1.059	2,20	140.526.518,35	2,61	23	1,79	4.523,38	1,34	1.059	2,20	140.521.994,97	2,61	3,477%	311,910
2051	1.077	2,24	153.581.383,27	2,86	18	1,40	3.438,87	1,02	1.077	2,24	153.577.944,40	2,86	2,901%	322,847
2052	1.460	3,04	198.887.453,74	3,70	18	1,40	5.371,10	1,59	1.460	3,04	198.882.082,64	3,70	2,728%	337,293
2053	4.717	9,81	696.604.006,27	12,96	47	3,66	10.804,96	3,21	4.717	9,81	696.593.201,31	12,96	2,674%	348,845
2054	1.172	2,44	157.657.703,62	2,93	19	1,48	2.742,80	0,81	1.172	2,44	157.654.960,82	2,93	3,401%	355,221

Medias ponderadas por el principal pendiente de vencimiento / Averages weighted by the outstanding principal.
Tipo Interés: Tipo de interés nominal anual / Interest Rate: Annual nominal interest rate.

BBVA RMBS 23 Fondo de Titulización

Cartera de Activos Titulizados / *Portfolio of Securitised Assets*

Distribución por Intervalos de Fecha de Vencimiento Final / *Distribution by Final Maturity Date Intervals*

Activos / *Assets*: Préstamos hipotecarios vivienda (PHs/CTHs) / *Residential mortgage loans (PTCs/MCs)*

Fecha / *Date*: 31/07/2024

Divisa / *Currency*: EUR

Intervalos anuales <i>Annual Intervals</i>	Saldo Vivo de Principal <i>Outstanding Principal Balance</i>				Principal Vencido Impagado <i>Overdue Principal</i>				Principal Pendiente Vencimiento <i>Outstanding Principal</i>				Tipo Interés <i>Interest Rate</i>	Vida residual <i>Residual Life</i>
	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	Media Pond. <i>W. Average</i>	M. Pond. Meses <i>W. Avg. Months</i>
2055	336	0,70	34.244.607,57	0,64	13	1,01	1.485,88	0,44	336	0,70	34.243.121,69	0,64	5,319%	372,393
2056	203	0,42	23.005.155,89	0,43	6	0,47	936,89	0,28	203	0,42	23.004.219,00	0,43	5,035%	382,267
2057	93	0,19	12.194.069,53	0,23	2	0,16	243,62	0,07	93	0,19	12.193.825,91	0,23	4,675%	396,365
2058	59	0,12	7.404.198,14	0,14	1	0,08	145,73	0,04	59	0,12	7.404.052,41	0,14	4,487%	406,414
2059	2	0,00	253.266,26	0,00	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	253.266,26	0,00	2,830%	420,087
2060	3	0,01	351.140,29	0,01	0	0,00	0,00	0,00	3	0,01	351.140,29	0,01	3,268%	430,262
2061	8	0,02	1.713.295,56	0,03	0	0,00	0,00	0,00	8	0,02	1.713.295,56	0,03	4,820%	443,967
2062	10	0,02	1.439.225,70	0,03	0	0,00	0,00	0,00	10	0,02	1.439.225,70	0,03	3,919%	456,517
2063	8	0,02	1.391.805,67	0,03	0	0,00	0,00	0,00	8	0,02	1.391.805,67	0,03	3,034%	469,377
Total :	48.099	100,00	5.375.441.180,99	100,00	1.284	100,00	336.994,01	100,00	48.099	100,00	5.375.104.186,98	100,00		
Media Ponderada / <i>Weighted Average</i> :													3,566%	270,437
Media Simple / <i>Average</i> :			111.757,86				262,46				111.750,85		3,732%	258,199
Mínimo / <i>Minimum</i> :			92,14				12,95				92,14		0,000%	31/03/2025
Máximo / <i>Maximum</i> :			1.874.919,10				1.911,90				1.874.919,10		8,773%	31/12/2063